

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

" گزارش افشای پرتفوی ماهانه "

در راستای اجرای ابلاغیه شماره ۱۲۰۲۰۰۹۳ مورخ ۱۳۹۶/۰۹/۰۵ سازمان بورس و اوراق بهادار

منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۳۹۷

فردین آقا بزرگی
مدیرعامل و عضو هیئت مدیره
کارگزاری بانک دی



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

۱- سرمایه گذاری ها

۱-۱- سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام

| شرکت | ۱۳۹۶/۰۲/۳۱ | | تغییرات طی دوره | | | | ۱۳۹۷/۰۳/۳۱ | | درصد به کل دارایی ها |
|--------------------|------------|----------------|-----------------|-------------|--------------|---------------|----------------|----------------|----------------------|
| | تعداد | بهای تمام شده | فروش طی دوره | | خرید طی دوره | | خالص ارزش فروش | | |
| | | | تعداد | مبلغ فروش | تعداد | بهای تمام شده | | | |
| بیمه دی | ۷,۱۶۱,۲۷۲ | ۷,۴۹۳,۱۹۳,۹۷۸ | ۴۰۰,۰۰۰ | ۴۳۳,۲۷۱,۱۵۳ | -۳۹۰,۰۰۰ | ۴۳۵,۸۶۳,۹۳۶ | ۷,۱۷۱,۲۷۲ | ۷,۹۷۸,۳۴۹,۶۸۴ | % ۱۳,۴۲ |
| سرمایه گذاری بوعلی | ۲۶,۳۷۰,۵۹۲ | ۲۸,۹۷۸,۴۴۱,۳۱۹ | ۲۳۷,۲۰۰ | ۲۱۹,۸۶۰,۹۶۱ | -۱۰۰,۰۰۰ | ۹۴,۶۷۰,۷۴۷ | ۲۶,۵۰۷,۷۹۲ | ۲۵,۵۲۰,۷۵۹,۰۵۵ | % ۴۲,۹۹ |
| جمع | ۳۳,۵۳۱,۸۶۴ | ۳۶,۴۷۱,۶۳۵,۲۹۷ | ۶۳۷,۲۰۰ | ۶۵۳,۱۳۲,۱۱۴ | -۴۹۰,۰۰۰ | ۵۳۰,۵۳۴,۶۸۳ | ۳۳,۶۷۹,۰۶۴ | ۳۶,۴۰۶,۹۵۵,۱۶۴ | % ۵۶/۴۲ |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

۱-۳- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

| ۱۳۹۷/۰۳/۳۱ | | تغییرات طی دوره | | ۱۳۹۶/۰۲/۳۱ | | مشخصات حساب بانکی | | | |
|----------------------|----------------|-----------------|----------------|----------------|--------------------|-------------------|-----------------|---------------|-----------------|
| درصد به کل دارایی‌ها | مبلغ | کاهش | افزایش | مبلغ | نرخ سود علی الحساب | تاریخ افتتاح حساب | نوع سپرده | شماره حساب | سپرده های بانکی |
| ۰/۰۰ | - | - | - | - | ۰ | ۱۳۹۵/۰۱/۲۸ | حساب جاری | ۰۱۰۳۵۷۴۸۰۸۰۰۴ | دی وزرا |
| ۰/۰۲ | ۱۰,۰۰۰,۰۰۰ | ۸۷۶,۵۸۰,۶۰۷ | ۸۷۶,۵۸۰,۶۰۷ | ۱۰,۰۰۰,۰۰۰ | ۰ | ۱۳۹۵/۰۸/۱۸ | حساب جاری | ۰۱۰۳۷۰۸۲۰۰۰۰۳ | دی وزرا |
| ۰/۴۲ | ۲۴۷,۰۵۶,۵۸۱ | ۲۰,۸۳۶,۰۵۴,۵۹۹ | ۵۷۶,۰۶۰,۵۸۹ | ۲۰,۵۰۷,۰۵۰,۵۹۱ | ۱۰ | ۱۳۹۵/۰۸/۱۸ | سپرده کوتاه مدت | ۰۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳ | دی وزرا |
| ۳۳/۶۱ | ۱۹,۹۵۹,۴۶۳,۹۹۲ | ۳۸۶,۸۱۷,۲۸۸ | ۲۰,۳۴۶,۲۸۱,۲۸۰ | - | ۲۱ | ۱۳۹۷/۰۳/۰۹ | سپرده کوتاه مدت | ۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲ | دی وزرا |
| ۳۴/۰۵ | ۲۰,۲۱۶,۵۲۰,۵۷۳ | ۲۲,۰۹۹,۴۵۲,۴۹۴ | ۲۱,۷۹۸,۹۲۲,۴۷۶ | ۲۰,۵۱۷,۰۵۰,۵۹۱ | | | | | جمع |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه گذاری ها

| شرح | یادداشت | مبلغ | درصد از کل درآمدها | درصد از کل دارایی |
|------------------------------|---------|---------------|--------------------|-------------------|
| سرمایه گذاری در سهام | ۱-۲ | ۱,۴۳۵,۷۰۸,۵۴۲ | ۲۵/۷۱ | ۲/۴۲ |
| سرمایه گذاری در اوراق بهادار | ۲-۲ | - | ۰ | ۰ |
| درآمد سپرده بانکی | ۳-۲ | ۳۰۲,۰۲۹,۵۷۳ | ۵/۴۱ | ۰/۵۱ |
| جمع | | ۱,۷۳۷,۷۳۸,۱۱۵ | ۳۱/۱۲ | ۲/۹۳ |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

درآمد سود سهام

| از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد ماه | | | طی خرداد ماه | | | اطلاعات مجمع | | | |
|---------------------------------------|-------------|--------------------|---------------------|-------------|--------------------|---------------------|--------------------------------|------------------|--------------------|
| خالص درآمد سود سهام | هزینه تنزیل | جمع درآمد سود سهام | خالص درآمد سود سهام | هزینه تنزیل | جمع درآمد سود سهام | سود متعلق به هر سهم | تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع | تاریخ تشکیل مجمع | نام سهام |
| ۵,۲۰۶,۳۶۴,۳۴۳ | ۶۷,۷۵۴,۰۵۷ | ۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰ | ۵,۲۰۶,۳۶۴,۳۴۳ | ۶۷,۷۵۴,۰۵۷ | ۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰ | ۲۰۰ | ۲۶,۳۷۰,۵۹۲ | ۱۳۹۷/۰۳/۰۱ | سرمایه‌گذاری پوعلی |
| ۵,۲۰۶,۳۶۴,۳۴۳ | ۶۷,۷۵۴,۰۵۷ | ۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰ | ۵,۲۰۶,۳۶۴,۳۴۳ | ۶۷,۷۵۴,۰۵۷ | ۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰ | | | | جمع |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

| از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد ماه | | | طی خرداد ماه | | | اطلاعات | | | |
|---------------------------------------|-------------|-------------|--------------|-------------|-------------|--------------------|--------------|------------------|---------|
| خالص درآمد | هزینه تنزیل | درآمد سود | خالص درآمد | هزینه تنزیل | درآمد سود | نرخ سود علی الحساب | تاریخ سررسید | تاریخ دریافت سود | شرح |
| - | - | - | - | - | - | ۰ | | ۱۷ | دی وزرا |
| - | - | - | - | - | - | ۰ | | ۱۷ | دی وزرا |
| ۵۹۴,۹۷۱,۲۳۶ | ۹۷۸ | ۵۹۴,۹۷۲,۲۱۴ | ۴۵,۲۴۷,۵۷۴ | -۱۹,۷۶۴ | ۴۵,۱۵۷,۸۱۰ | ۱۰ | | ۳۰ | دی وزرا |
| ۲۵۲,۵۱۳,۳۱۴ | ۴,۳۵۸,۴۴۹ | ۲۵۶,۸۷۱,۷۶۳ | ۲۵۲,۵۱۳,۳۱۴ | ۴,۳۵۸,۴۴۹ | ۲۵۶,۸۷۱,۷۶۳ | ۲۱ | | ۳۰ | دی وزرا |
| ۸۴۷,۴۸۴,۵۵۰ | ۴,۳۵۹,۴۲۷ | ۸۵۱,۸۴۳,۹۷۷ | ۲۹۷,۷۶۰,۸۸۸ | ۴,۲۶۸,۶۸۵ | ۳۰۲,۰۲۹,۵۷۳ | | | | جمع |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

| از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد ماه | | | | طی خرداد ماه | | | | شرح |
|---------------------------------------|---------------|----------------|-----------|-------------------------|-------------|----------------|---------|--------------------|
| سود و زیان ناشی از فروش | ارزش دفتری | خالص ارزش فروش | تعداد | سود و زیان ناشی از فروش | ارزش دفتری | خالص بهای فروش | تعداد | |
| -۴,۵۸۴,۵۱۰ | ۱۴۸,۹۶۷,۰۷۲ | ۱۴۴,۳۸۲,۵۶۲ | ۱۵۰,۰۰۰ | -۴,۹۹۳,۹۰۹ | ۹۹,۶۶۴,۶۵۶ | ۹۴,۶۷۰,۷۴۷ | ۱۰۰,۰۰۰ | سرمایه گذاری بوعلی |
| -۱۲,۸۵۹,۸۱۳ | ۱,۳۰۶,۸۶۴,۴۸۷ | ۱,۲۹۴,۰۰۴,۶۷۴ | ۱,۲۰۰,۱۶۹ | ۱۱,۴۰۲,۲۰۶ | ۴۲۴,۴۶۱,۷۳۰ | ۴۳۵,۸۶۳,۹۳۶ | ۳۹۰,۰۰۰ | بیمه دی |
| -۱۷,۴۴۴,۳۲۳ | ۱,۴۵۵,۸۳۱,۵۵۹ | ۱,۴۳۸,۳۸۷,۲۳۶ | ۱,۳۵۰,۱۶۹ | ۶,۴۰۸,۲۹۷ | ۵۲۴,۱۲۶,۳۸۶ | ۵۳۰,۵۳۴,۶۸۳ | ۴۹۰,۰۰۰ | جمع |

ارزش دفتری برابر است با میانگین موزون خالص ارزش فروش هر سهم/ورقه در ابتدای دوره با خرید طی دوره ضربدر تعداد در پایان دوره

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

| از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد ماه | | | | طی خرداد ماه | | | | شرح |
|---|----------------|----------------|------------|-------------------------------|----------------|----------------|------------|--------------------|
| سود و زیان ناشی از تغییر قیمت | ارزش دفتری | خالص ارزش فروش | تعداد | سود و زیان ناشی از تغییر قیمت | ارزش دفتری | خالص ارزش فروش | تعداد | |
| -۸۸۸,۱۴۰,۴۲۹ | ۲۶,۴۱۸,۸۹۹,۴۸۴ | ۲۵,۵۳۰,۷۵۹,۰۵۴ | ۲۶,۵۰۷,۷۹۲ | -۳,۹۵۴,۱۲۴,۶۴۱ | ۲۹,۴۸۴,۸۸۳,۶۹۶ | ۲۵,۵۳۰,۷۵۹,۰۵۴ | ۲۶,۵۰۷,۷۹۲ | سرمایه گذاری بوعلی |
| ۱۷۵,۴۷۳,۷۹۳ | ۷,۸۰۲,۸۷۵,۸۹۰ | ۷,۹۷۸,۳۴۹,۶۸۳ | ۷,۱۷۱,۲۷۲ | ۱۰۹,۳۰۶,۴۸۶ | ۷,۸۶۹,۰۴۳,۱۹۷ | ۷,۹۷۸,۳۴۹,۶۸۳ | ۷,۱۷۱,۲۷۲ | بیمه دی |
| -۷۱۲,۶۶۶,۶۳۶ | ۳۴,۲۲۱,۷۷۵,۳۷۴ | ۳۳,۵۰۹,۱۰۸,۷۳۷ | ۳۳,۶۷۹,۰۶۴ | -۳,۸۴۴,۸۱۸,۱۵۵ | ۳۷,۳۵۳,۹۲۶,۸۹۳ | ۳۳,۵۰۹,۱۰۸,۷۳۷ | | جمع |
| ارزش دفتری برابر است با میانگین موزون خالص ارزش فروش هر سهم/ورقه در ابتدای دوره با خرید طی دوره ضربدر تعداد در پایان دوره | | | | | | | | |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

۱-۲- درآمدها حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام:

| | از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد ماه | | | | طی خرداد ماه | | | | | | |
|--|---------------------------------------|---------------|-------------|------------------|----------------|--------------------|---------------|-------------|----------------|------------------|--------------------|
| | جمع | | درآمد فروش | درآمد تغییر ارزش | درآمد سود سهام | جمع | | درآمد فروش | | درآمد تغییر ارزش | درآمد سود سهام |
| | درصد از کل درآمدها | مبلغ | یادداشت ... | یادداشت ... | یادداشت ... | درصد از کل درآمدها | مبلغ | یادداشت ... | | یادداشت ... | یادداشت ... |
| | -۸۱.۱۱ % | ۴,۳۸۱,۳۹۳,۴۶۱ | -۴,۵۸۴,۵۱۰ | -۸۸۸,۱۴۰,۴۲۹ | ۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰ | ۲۳.۵۵ % | ۱,۳۱۴,۹۹۹,۸۵۰ | -۴,۹۹۳,۹۰۹ | -۳,۹۵۴,۱۲۴,۶۴۱ | ۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰ | سرمایه گذاری بوعلی |
| | -۳۰.۱ % | ۱۶۲,۶۱۳,۹۸۰ | -۱۲,۸۵۹,۸۱۳ | ۱۷۵,۴۷۳,۷۹۳ | - | ۲.۱۶ % | ۱۲۰,۷۰۸,۶۹۳ | ۱۱,۴۰۲,۲۰۶ | ۱۰۹,۳۰۶,۴۸۶ | - | بیمه دی |
| | -۸۴/۱۲ | ۴,۵۴۴,۰۰۷,۴۴۱ | -۱۷,۴۴۴,۳۲۳ | -۷۱۲,۶۶۶,۶۳۶ | ۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰ | ۲۵/۷۱ | ۱,۴۳۵,۷۰۸,۵۴۲ | ۶,۴۰۸,۲۹۷ | -۳,۸۴۴,۸۱۸,۱۵۵ | ۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰ | جمع |

صندوق سرمایه گذاری بازارگردانی گروه مالی دی
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

۲-۳- درآمد حاصل از سرمایه-گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده:

| از ابتدای سال مالی تا پایان خرداد ماه | | طی خرداد ماه | | نام سپرده بانکی | |
|---------------------------------------|-------------------------------|---------------------------|-------------------------------|-----------------|-----------|
| درصد سود به میانگین سپرده | سود سپرده بانکی و گواهی سپرده | درصد سود به میانگین سپرده | سود سپرده بانکی و گواهی سپرده | شماره حساب | نام سپرده |
| - | - | - | - | ۰۱۰۳۵۷۴۸۰۸۰۰۴ | دی وزرا |
| - | - | - | - | ۰۱۰۳۷۰۸۲۰۰۰۰۳ | دی وزرا |
| - | ۵۹۴,۹۷۲,۲۱۴ | - | ۴۵,۱۵۷,۸۱۰ | ۰۲۰۳۷۱۰۰۱۸۰۰۳ | دی وزرا |
| - | ۲۵۶,۸۷۱,۷۶۳ | - | ۲۵۶,۸۷۱,۷۶۳ | ۰۲۰۴۶۵۶۰۹۲۰۰۲ | دی وزرا |
| - | ۸۵۱,۸۴۳,۹۷۷ | - | ۳۰۲,۰۲۹,۵۷۳ | | جمع |